

Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 28 de Agosto de 2006 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$376,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,9	104,7	67,6	35,8	140,5
15-35	60,3	122,7	117,5	55,1	177,9
36-60	3,7	0,4	0,4	3,7	4,1
61-90	1,0	1,5	1,5	1,0	2,6
91-180	20,2	1,4	1,4	20,2	21,6
>180	29,2	0,0	0,0	29,2	29,3
Total	187,4	230,9	188,6	145,1	376,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	1,9 %
15-35	0,6 %	2,0 %
36-60	2,5 %	0,1 %
61-90	0,6 %	1,9 %
91-180	1,5 %	3,0 %
>180	2,8 %	2,8 %
Total	0,6 %	2,1 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	28 de Ago. al 1 de Septiembre				4 al 8 de Septiembre				11 al 15 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	24	991	776	15	15	470	434	16	17	531	580
Real	24	26	496	711	15	15	345	382	17	16	511	463
Total	50	50	1487	1487	30	30	816	816	33	33	1043	1043

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 29 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.